



Definition – Message Catalogue

Date: February 14, 2019

iMercado – Pre-Matching

iMercado – Pre-Matching

Message Definitions Report

This document describes a series of message definitions developed by B3 to be used in iMercado Pre-Matching processes.



Change Log

Date	Version	Description
Apr. 10, 2017	1.0	First draft
Jul. 03, 2017	1.0	Modification of the setr.044.001.02 message
Jul. 13, 2018	1.1	1. Modification of the setr.027.001.02 message 2. Creation of the setr.029.001.01 message 3. Creation of the setr.030.001.01 message 4. Modification of the setr.044.001.02 message
Jul. 24, 2018	1.1	Inclusion of the Data Type Details information column in all messages.
Sep. 06, 2018	1.2	Creation of the SUPL.setr.044.001.02 message Modifications to the setr.030.001.01, setr.029.001.01 and setr.027.001.03 messages Creation of the SUPL.setr.029.001.01 message
Jan. 30, 2019	1.3	Changes to the setr.029.001.01, setr.027.001.03, SUPL. setr.027.001.03, setr.044.001.02 and SUPL.setr.044.001.02 messages.
Feb. 14, 2019	1.4	Changes to the SUPL.setr.027.001.03.

Detailed description in the “Change Log” document.



Schema Version

This catalogue version encompasses the XSD schema versions below.

Message Name	XSD Schema Version
setr.027.001.03	1.3
SUPL.setr.027.001.03	1.3
setr.029.001.01	1.2
SUPL.setr.029.001.01	1.0
setr.030.001.01	1.1
setr.044.001.02	2.4
SUPL.setr.044.001.02	1.1



Content

Change Log	2
Schema Version	3
Overview	6
<i>Scope</i>	6
<i>Message List</i>	7
<i>How to read</i>	8
Message Flows	9
<i>Sends Pre-Matching</i>	9
Introduction.....	9
Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends pre-matching - Matched.....	9
Scenario 2: Full Trading Participant or Settlement Participant sends pre-matching - Unmatched	10
Scenario 3: Custodian sends pre-matching	12
Scenario 4: Full Trading Participant sends pre-matching - Matched.....	12
<i>Pre-Matching Cancellation</i>	13
Introduction.....	13
Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant requests pre-matching cancellation	13
Scenario 2: Custodian requests pre-matching cancellation	14
setr.027.001.03 – SecuritiesTradeConfirmation	15
Message functionality	15



Rules 16

Message Structure – SecuritiesTradeConfirmation (setr.027.001.03) 16

Message Structure – Supplementary Data SUPL.setr.027.001.03 - SecuritiesTradeConfirmationSD 24

setr.044.001.02 - SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice 26

 Message functionality 26

 Rules 26

 Message Structure – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice (setr.044.001.02) 27

 Message Structure SUPL.setr.044.001.02 – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice 31

setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation 34

 Message functionality 34

 Rules 34

 Message Structure - setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation 34

 Message Structure SUPL.setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation 35

setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse 37

 Message functionality 37

 Rules 37

 Message Structure - setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse 38



Definition – Message Catalogue

Date: February 14, 2019

iMercado – Pre-Matching

Overview

Scope

This document describes the series of message definitions developed by B3 that will be used in the pre-matching flows of iMercado.

Trading scenarios were modeled and a series of XML messages conceived. In due course, these messages will be submitted to the ISO20022 registration body for approval. Each trading scenario is represented by a standardized work flow and a fixed number of normalized messages.



Message List

1. **SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03>**

The SecuritiesTradeConfirmation message is sent by the Full Trading Participant (FTP), Settlement Participant (SP) or Custodian (CST) via iMercado and provides consolidated pre-matching details by customer and by instrument.

2. **SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02>**

The SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to notify pre-matching conciliation status.

3. **SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01>**

The SecuritiesTradeConfirmationCancellation message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to request pre-matching cancellation.

4. **SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01>**

The SecuritiesTradeConfirmationResponse message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to confirm the Pre-Matching Cancellation request.



Definition – Message Catalogue

Date: February 14, 2019

iMercado – Pre-Matching

How to read

Unified Modeling Language (UML) has been used to describe logical and business models. As an understanding of UML is not a requirement for the discussion about business standards, the data format for messages is presented in a friendlier way. This manner of representation is generated automatically from models, thus assuring that the model's information is absolutely congruent with the published rule.



Message Flows

Sends Pre-Matching

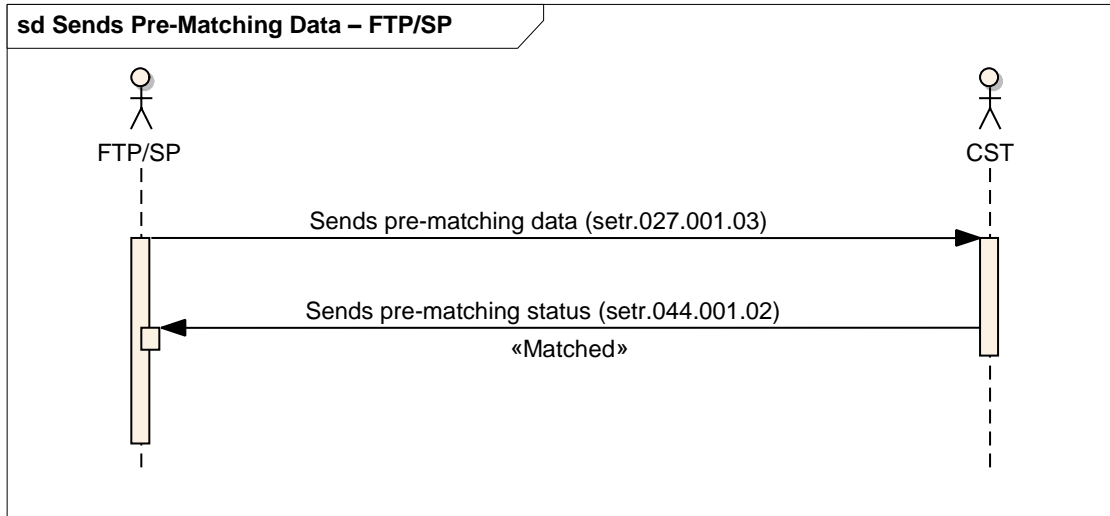
Introduction

This flow illustrates use of the SecuritiesTradeConfirmation message in typical sequential scenarios to send the Custodian, Full Trading Participant or Settlement Participant consolidated settlement data by customer and by traded instrument.

Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends pre-matching - Matched

This is the most basic and elementary scenario for sending consolidated pre-matching data to the Custodian.

- The Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> message to the Custodian (CST), notifying the pre-matching data;
- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP), notifying the pre-matching – Matched data conciliation status.



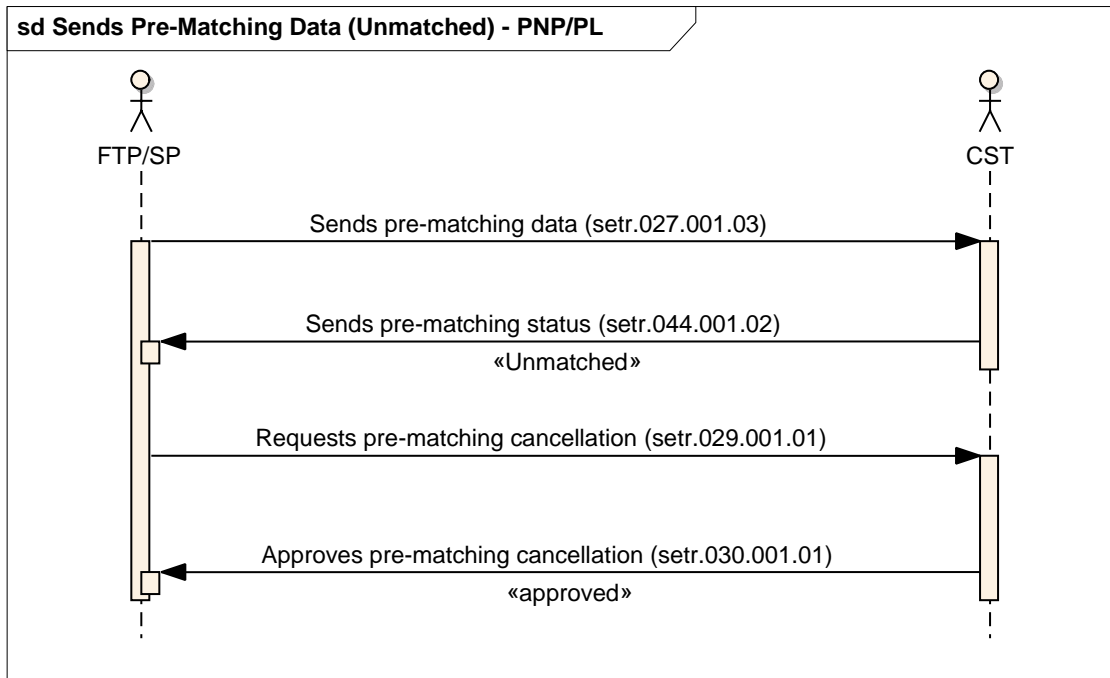
Scenario 2: Full Trading Participant or Settlement Participant sends pre-matching - Unmatched

This is the most basic and elementary scenario for sending consolidated pre-matching data to the Custodian.

- The Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> message to the Custodian (CST), notifying the pre-matching data;
- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP), notifying the pre-matching – Unmatched conciliation data status;



- The Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> message to the Custodian (CST), requesting pre-matching cancellation;
- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP), confirming pre-matching cancellation.

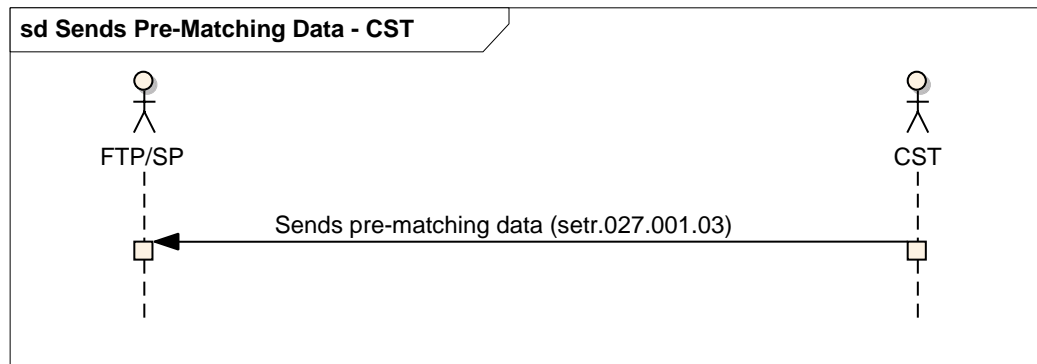




Scenario 3: Custodian sends pre-matching

This is the most basic and elementary scenario for sending consolidated pre-matching data the Full Trading Participant or Settlement Participant.

- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP), notifying the pre-matching data.



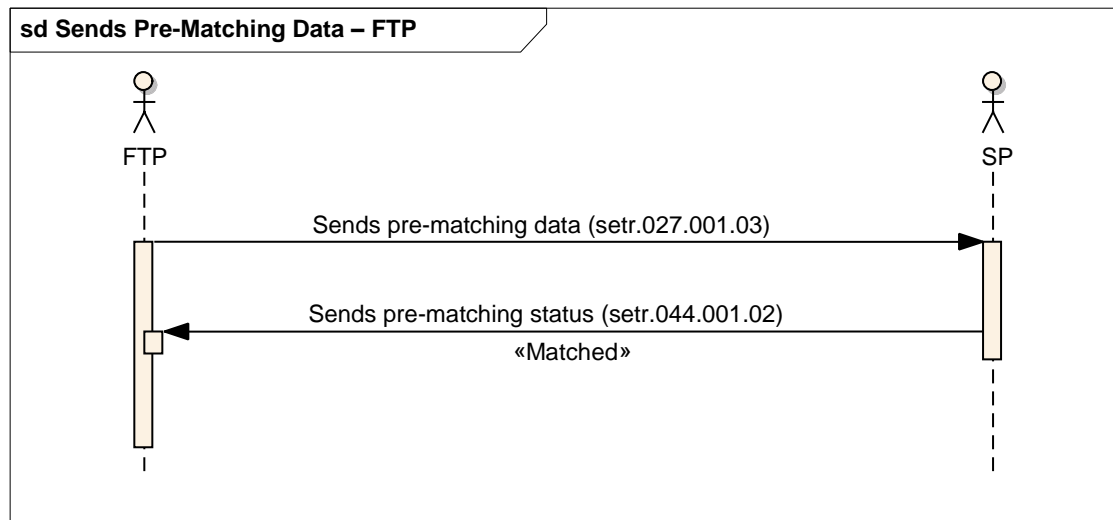
Scenario 4: Full Trading Participant sends pre-matching - Matched

This is the most basic and elementary scenario for sending consolidated pre-matching data to the Settlement Participant (SP).

- The Full Trading Participant (FTP) sends the SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> message to the Settlement Participant (SP), notifying the pre-matching data;



- The Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> message to the Full Trading Participant (FTP), notifying the pre-matching – Matched data conciliation status.



Pre-Matching Cancellation

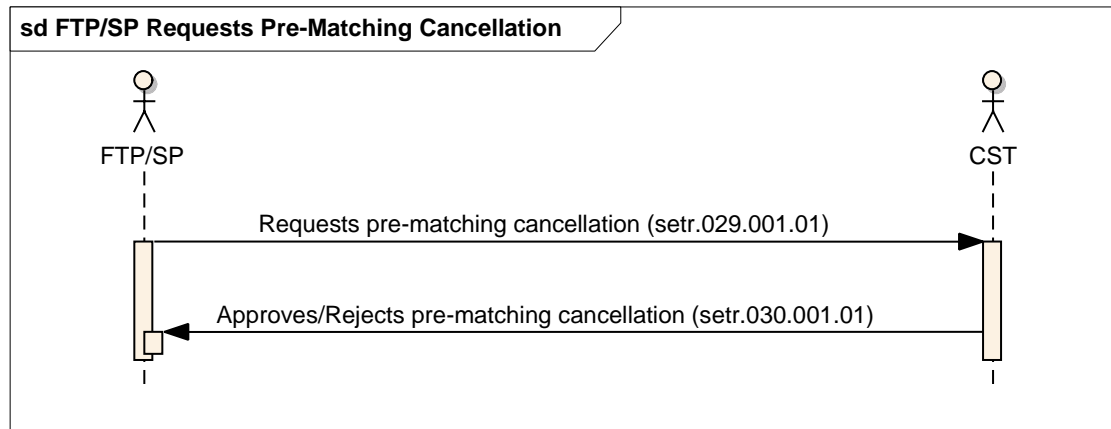
Introduction

This flow illustrates use of the SecuritiesTradeConfirmationCancellation message in typical sequential scenarios to request pre-matching cancellation.

Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant requests pre-matching cancellation

This is the most basic and elementary scenario for the Full Trading Participant or Settlement Participant to request pre-matching cancellation.

- The Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> message to the Custodian (CST) requesting pre-matching cancellation;
- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) confirming pre-matching cancellation.



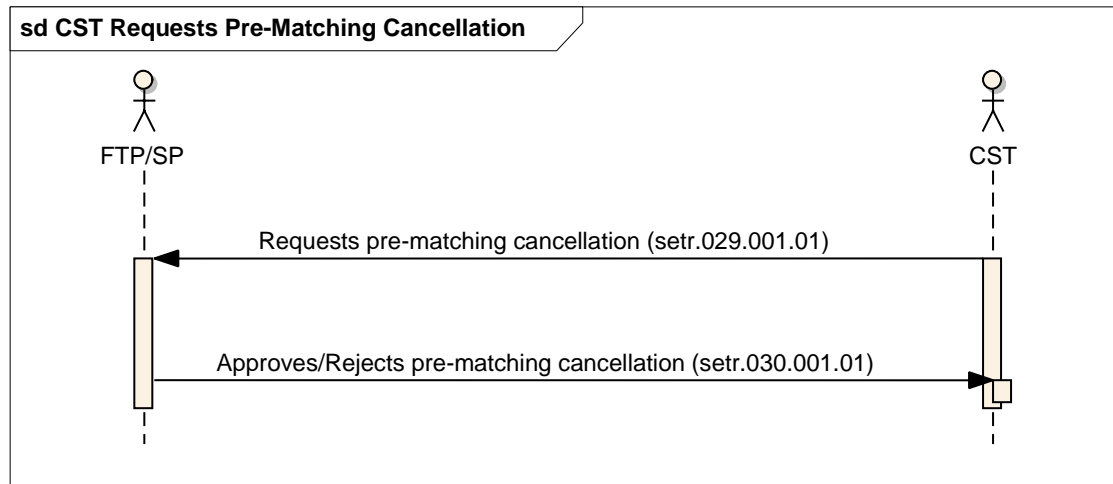
Scenario 2: Custodian requests pre-matching cancellation

This is the most basic and elementary scenario for the Full Trading Participant or Settlement Participant to request pre-matching cancellation.

- The Custodian (CST) sends the SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> message to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP), requesting pre-matching cancellation;



- The Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) sends the SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> message to the Custodian (CST), confirming pre-matching cancellation.



setr.027.001.03 – SecuritiesTradeConfirmation

Message functionality

The SecuritiesTradeConfirmation message is sent by the Full Trading Participant (FTP), Settlement Participant (SP) or Custodian (CST) via iMercado and provides details of consolidated pre-matching information by customer and by instrument.



Rules

R1. Unique option for this block.

R2. Field informed only when the message is send by the broker

Message Structure – SecuritiesTradeConfirmation (setr.027.001.03)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	Txid	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[1..1]	+		Reference to the Pre Match identifier.	Referência à identificação do Pre Match.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique reference agreed upon by the two trade counterparties to identify the Pre Match	Este campo identifica Pre Match ID	R1
3.0		TradeDetails	TradDtIs	[1..1]	+		Details of the trade.	Detalhes de um bloco de negócio.	
3.1		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
3.2		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
3.2.1		Date	Dt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be traded.	Data do pregão em que o negócio foi executado.	
3.2.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Numeric representation of the day of the month and year.	Representação numérica do dia, mês e ano no formato ISO.	
3.3		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be delivered or received.	Data de liquidação.	
3.3.1		Date	Dt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be delivered or received.	Data em que os títulos devem ser entregues ou recebidos.	
3.3.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Numeric representation of the day of the month and year.	Representação numérica do dia, mês e ano no formato ISO.	



3.4		ConfirmationQuantity	ConfQty	[1..1]	+		Identifies the trade quantity.	Quantidade negociada.	
3.4.1		Quantity	Qty	[1..1]	+		Quantity of financial instrument in units, original face amount or current face amount.	Quantidade de instrumentos financeiros em unidades, quantia original ou quantia atual.	
3.4.1.1		Unit	Unit	[1..1]		DecimalNumber decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.5		GrossTradeAmount	GrssTradeAmt	[0..1]	+		This block informs the gross trade amount.	Este bloco informa o volume bruto negociado.	R2
3.5.1		Amount	Amt	[1..1]		ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
3.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]		CreditDebitCode string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
3.6		DealPrice	DealPric	[0..1]	+		Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco especifica a cotação do instrumento financeiro negociado.	R2
3.6.1		Value	Val	[1..1]	+		Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
3.6.1.1		Amount	Amt	[1..1]		ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrMld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier of a financial instrument, assigned under a formal or proprietary identification scheme.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	
4.1		ISIN	ISIN	[0..1]		ISINIdentifier string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde: a) os dois primeiros caracteres (BR)	



								<p>identificam o código do BRASIL;</p> <p>b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor;</p> <p>c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência;</p> <p>d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e</p> <p>e) o último caractere (7) é o dígito de controle.</p>	
5.0		ConfirmationParties	ConfParties	[1..1]	+		Parties involved in the confirmation of the details of a trade.	Partes envolvidas na confirmação dos detalhes de um negócio.	
5.1		ExecutingBroker	ExctgBroker	[1..1]	+		Party responsible for executing an order (for example, an executing or give-up broker). Usually a commission is charged to the client for executing an order.	Parte responsável pela execução de uma ordem.	
5.1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
5.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



							Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.
5.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.
5.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.
5.2		TradeBeneficiaryParty	TradBnf cryPty	[1..1]	+		This block identifies the custodian and account.	Este bloco identifica o agente de custódia e a conta de custódia.
5.2.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.
5.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.
5.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength =	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a	Identificação única como é conhecida uma instituição usando



						35 minLength = 1	proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.2.2		SafekeepingAccount	SfkpgAct	[1..1]	+		This block identifies the custodian account.	Este bloco identifica a conta de custódia.	
5.2.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	



7.2.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.3		WithholdingTax	WhldgTax	[0..1]	+		Amount of money that will be withheld by a tax authority.	Valor do imposto.	
7.3.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.3.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.4		NetGainLoss	NetGnLoss	[1..1]	+		Amount representing the difference between the cost and the current price of a security. In the context of securities settlement, it is the amount paid or received when the instructions are netted or paired off.	Valor do volume líquido.	
7.4.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.4.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.5		LocalTaxCountrySpecific1	LclTaxCountrySpfc1	[0..1]	+		Registration fee.	Taxa de registro.	
7.5.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	



7.6		LocalTaxCountrySpecific2	LclTaxCountrySpfc2	[0..1]	+		Settlement fee.	Taxa de liquidação.	
7.6.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.6.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.7		Other	Othr	[0..1]	+		Other tax.	Outras taxas	
7.7.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.7.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
8.0		Supplementary Data	SplmtryData	[1..1]	+		Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.	
8.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
8.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	



8.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	
-------	--	----------	------	--------	---	--	---	--	--

Message Structure – Supplementary Data SUPL.setr.027.001.03 - SecuritiesTradeConfirmationSD

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		FinancialInstrumentAttributesInformation	FinInstrmAttrbtsInf	[1..1]	+		Informations of the elements characterising a financial instrument.	Informações das características de um instrumento.	
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/FinInstrmId	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/FinInstrmId	
1.2		DistributionIdentification	Dstrbtnd	[0..1]	int	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
1.3		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da	



								BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
1.4		Market	Mkt	[0..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot Market 2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external is ExternalMarketCode</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONÍVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL 4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO A TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
1.5		TickerSymbol	TckrSymbol	[0..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.</p>	<p>Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3</p>	



1.6		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	<p>Specifies how the transaction is to be settled. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	<p>Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
-----	--	-------------	-------	--------	-------------------------	-----	--	--	--

setr.044.001.02 - SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice

Message functionality

The SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to notify consolidated pre-matching conciliation status.

Rules

R1. If the participant approves with no justification required, it must send only the "Matched (Mtchd)" tag. If more information is required about the approval, the "AdditionalReasonInformation (AddtIRsnInf)" tag must be used.

R2. The "ExecutingPartyTransactionIdentification" and "CommonIdentification" assignments are mandatory and must be sent in this order for the XML to be filled out.



Message Structure – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice (setr.044.001.02)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[2..2]	+		Reference to the transaction identifier issued by a business party, it may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message setr.027.001.03.	Referência à identificação da transação feito por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem setr.027.001.03.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	R2
2.1.1	{OR	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPartyTxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.1.2	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique reference agreed upon by the two trade counterparties to identify the Pre Match	Este campo identifica Pre Match ID	
3.0		MatchingStatus	MtchgStatus	[1..1]	+		Provides details on the matching status of a trade	Fornecer detalhes do status de matching de um negócio.	
3.1	{OR	Matched	Mtchd	[1..1]	+		Trade is matched.	Negócio aceito.	R1
3.1.1		AdditionalReasonInformation	AddlReasonInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the processed instruction.	Este campo contém informações adicionais sobre o status Matched.	
3.2	OR}	Unmatched	Umtchd	[1..1]	+		Trade is unmatched or mismatched.	Negócio recusado.	
3.2.1		Reason	Rsn	[1..*]	+		Specifies the reason of the UnmatchStatus.	Especifica o motivo do não aceite.	
3.2.1.1		Code	Cd	[1..1]	+		Specifies the reason why the instruction has an unmatched status.	Informa o motivo do status estar unmatched.	



3.2.1.1.1		Code	Cd	[1..1]	UnmatchedReason4Code	string	Specifies the reason why the instruction has an unmatched status.	Informa o motivo do status estar unmatched.	
3.2.1.2		AdditionalReasonInformation	AddlRsnInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the unmatched reason. Must be filled with the value expected by or the amount expected by the participant.	Este campo contém informações adicionais sobre o unmatched. Deve ser preenchido com o valor esperado pelo participante ou a quantidade esperada pelo participante.	
3.2.2	OR}	NoSpecifiedReason	NoSpcdfRsn	[1..1]	NoReasonCode	string	Indicates that there is no reason available or to report.	Este campo deve ser preenchido quando o participante não deseja informar o motivo pela qual não concorda com os dados informados.	
4.0		ConfirmationParties	ConfPties	[1..1]	+		Parties involved in the confirmation of the details of a trade.	Partes envolvidas na confirmação dos detalhes de um negócio.	
4.1		ExecutingBroker	ExctgBrkr	[1..1]	+		This block contains the participant identification.	Este bloco contém a identificação do participante.	
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
4.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores	



							allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.2		Investor	Invstr	[0..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.1		SafekeepingAccount	SfkpgAcct	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.3		TradeBeneficiaryParty	TradBnf cryPty	[1..1]	+		Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e conta de custódia.	
4.3.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
4.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



							This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.3.2		SafekeepingAccount	SfkpgAct	[1..1]	+		This block identifies the custodian account.	Este bloco identifica a conta de custódia.	
4.3.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	



5.0		Supplementary Data	Splmtry Data	[1..1]	+			Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	115 = Número da Conta Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1		Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.
5.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+			Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.
5.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+			Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.

Message Structure SUPL.setr.044.001.02 – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		SecuritiesTrade Information	SctiesTradInf	[1..1]	+		Provides additional trade informations.	Fornecer informações adicionais do negócio.	
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/SctiesTradConfStsAdv	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesTradConfStsAdv	
1.2		OtherAmounts	OthrAmts	[1..1]	+		This block contains the trade taxes.	Este bloco contém informações das taxas referente a um negócio.	



1.2.1		ChargesFees	ChrgsFees	[0..1]	+		Amount of money paid for the provision of financial services that cannot be categorised by another qualifier.	Valor da taxa de emolumento.	
1.2.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.1.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.2		LocalBrokerCommission	LclBrkrComssn	[0..1]	+		Amount of commission paid to a local broker.	Valor da taxa de corretagem.	
1.2.2.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.2.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.3		WithholdingTax	WhldgTax	[0..1]	+		Amount of money that will be withheld by a tax authority.	Valor do imposto.	
1.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.3.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.4		NetGainLoss	NetGnLoss	[1..1]	+		Amount representing the difference between the cost and the current price of a security. In the context of securities settlement, it is the amount paid or received when the instructions are netted or paired off.	Valor do volume líquido.	



1.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.4.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.5		LocalTaxCountrySpecific1	LclTaxCountrySpfc1	[0..1]	+		Registration fee.	Taxa de registro.	
1.2.5.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.6		LocalTaxCountrySpecific2	LclTaxCountrySpfc2	[0..1]	+		Settlement fee.	Taxa de liquidação.	
1.2.6.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
1.2.6.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.7		Other	Othr	[0..1]	+		Other tax.	Outras taxas	
1.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	



1.2.7.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
---------	--	----------------------	-----------	--------	-----------------	--------	--	--------------------------------------	--

setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation

Message functionality

The SecuritiesTradeConfirmationCancellation message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to request pre-matching cancellation.

Rules

R1. Unique option for this block.

Message Structure - setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[1..1]	+		Reference to the Pre Match identifier.	Referência à identificação do Pre Match.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique reference agreed upon by the two trade counterparties to identify the Pre Match	Este campo identifica Pre Match ID	R1



3.0		Supplementary Data	Splmtry Data	[1..1]	+		Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
3.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	
3.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	

Message Structure SUPL.setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		ParticipantInformation	PtcptInf	[1..1]	+		Provides information about the Participant who requested the cancellation.	Fornecer informações sobre o Participante que solicitou o cancelamento.	



1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/SciesTradConfCxl	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SciesTradConfCxl	
1.2		ParticipantIdentification	Ptcptld	[1..1]	+		Identification of the Participant.	Identificação do Participante.	
1.2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	ld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	



1.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
1.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	

setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse

Message functionality

The SecuritiesTradeConfirmationResponse message is sent by the Custodian (CST), Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to confirm the Pre-Matching Cancellation request.

Rules

R1. The "ExecutingPartyTransactionIdentification" and "CommonIdentification" assignments are mandatory and must be sent in this order for the XML to be filled out.



Message Structure - setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[2..2]	+		Reference to the transaction identifier issued by a business party. it may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message setr.029.001.01.	Referência à identificação da transação feito por um participante. usado para fazer referência a uma transação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem setr.029.001.01.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	R1
2.1.1	{OR	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPartyTxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.1.2	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique reference agreed upon by the two trade counterparties to identify the Pre Match	Este campo identifica Pre Match ID	
3.0		Status	Sts	[1..1]	+		This block contains the details about accepting or rejecting Pre Match cancellation.	Este bloco contém os detalhes sobre o aceite ou rejeição do cancelamento do Pre Match.	
3.1		Affirmations	AffirmSts	[1..1]	+		This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
3.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmStatus1Code	string	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	
3.2		AdditionalReasonInformation	AddlRsnInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength =	Provides additional information about the reject reason.	Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.	



Definition – Message Catalogue

Date: September 06, 2018

iMercado Pre-Matching

						210 minLength = 1			
--	--	--	--	--	--	----------------------	--	--	--